

CoVaR Methode (with Tobias Adrian)

1. Finde **optimalen Mix**/trade-offs zwischen Größe, Leverage, ... **objective**
2. **Antizyklische** Implementierung **zukunftsgewandte Gewichtung**

Methode:

- *Schätze* zukünftigen ΔCoVaR mittels
 - Größe, Fristendiskrepanz, Leverage
 - Spezialdaten, die nur Regulierungsbehörden haben (e.g. crowdedness, interconnectedness measures)